

Gouvernance des outils et des systèmes

PILOTAGE DE L'INTÉGRATION DE NOUVEAUX INDICATEURS DE RISQUES (STRESS TESTS SPÉCIFIQUES) DANS LE SYSTÈME DE SUIVI DES RISQUES DE MARCHÉ D'UN GROUPE BANCAIRE FRANÇAIS

- Recueil du besoin des équipes de Risk Control et Risk Management des périmètres Taux, Crédit, Change, Commodities...
- Spécifications des indicateurs de risque à intégrer, recette fonctionnelle et mise en production dans l'outil interne
- Spécification de l'ensemble des reporting de risque (P&L, VaR, Sensibilités, Stress tests...), formation des utilisateurs

PROJET DE REFONTE DE LA LIBRAIRIE DE PRICING DU MOTEUR DE CALCUL DES EXPOSITIONS AU RISQUE DE CONTREPARTIE ÉCONOMIQUE (EXPOSITIONS ET CVA) ET RÈGLEMENTAIRE (EEPE, EEPE STRESSÉE, BACKTESTING) POUR UN GROUPE BANCAIRE FRANÇAIS

- Road Map du projet, cartographie initiale du portefeuille, objectifs à atteindre, lotissement des tâches, planification détaillée
- Conception de la librairie répondant aux spécificités du calcul des expositions
- Optimisation des modèles de pricing selon le ratio complexité-performance/précision, validation du dispositif et de la qualité de pricing

MISE EN PLACE D'UN OUTIL DE COLLECTE ET DE PRODUCTION DE SCÉNARIOS MACROÉCONOMIQUES STRESSÉS POUR UN GROUPE BANCAIRE FRANÇAIS

- Étude de cadrage visant à définir une cible applicative permettant d'industrialiser le processus de production des stress tests
- Définition des priorités, rédaction des EDB et des spécifications fonctionnelles, recette des outils et support aux utilisateurs
- Mise en place d'une nomenclature des séries temporelles utilisées afin de rationaliser le processus de collecte